

---

# 招商资管智远天添利货币型集合资产管理计划

## 2023年第2季度报告

### 2023年06月30日

基金管理人:招商证券资产管理有限公司

基金托管人:中国证券登记结算有限责任公司

报告送出日期:2023年07月20日

## §1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国证券登记结算有限责任公司根据本集合计划合同规定，于2023年7月19日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本集合计划的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2023年4月1日起至2023年6月30日止。

## §2 基金产品概况

|            |  |
|------------|--|
| 基金简称       | 招商资管智远天添利货币  |
| 基金主代码      | 880013   |
| 基金运作方式     | 契约型开放式   |
| 基金合同生效日    | 2022年04月25日  |
| 报告期末基金份额总额 | 37,932,975,205.12份   |
| 投资目标       | 本集合计划是在不影响委托人正常证券交易的前提下，委托人用资金账户中的资金申购本集合计划。本集合计划将主要投资于各类存款、债券回购等短期金融工具，并适当配置一定比例的固定收益类金融产品，从而力争为委托人取得超越活期存款利率的收益。 |
| 投资策略       | 本集合计划通过对货币政策、宏观经济运行状况、利率走势、资金供求变化情况进行深入研究，评估各类投资品种的流动性、收益性和风险特征，确定各类投资品种的配置比例及期                                    |

|        |  |
|--------|--|
|        | 限组合，并适时进行动态调整。由于本集合计划的目的是在不影响委托人的正常证券交易下，实现客户交易结算资金的增值，因此本集合计划的投资应坚持下列原则：（1）确保集合计划资产充分的流动性或者有相应的应急措施能保证委托人的正常交易；（2）确保集合计划资产充分的安全性或者有相应的应急措施保证委托人的资产安全与避免负收益的出现；（3）在遵循上述两条原则的前提下，合理安排集合计划资产流动性，实现集合计划资产的增值。 |
| 业绩比较基准 | 中国人民银行公布的活期存款基准利率（税后）*100%   |
| 风险收益特征 | 本集合计划为货币市场型集合资产管理计划，预期风险和预期收益与货币市场基金相同，低于债券型基金、混合型基金和股票型基金。  |
| 基金管理人  | 招商证券资产管理有限公司   |
| 基金托管人  | 中国证券登记结算有限责任公司   |

注：本报告所述的“基金”也包括按照《证券公司大集合资产管理业务适用<关于规范金融机构资产管理业务的指导意见>操作指引》的要求进行变更后的证券公司大集合资产管理产品。

### §3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标     | 报告期（2023年04月01日 - 2023年06月30日） |
|------------|--------------------------------|
| 1.本期已实现收益  | 125,097,748.38                 |
| 2.本期利润     | 125,097,748.38                 |
| 3.期末基金资产净值 | 37,932,975,205.12              |

注：（1）本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。由于本集合计划采用摊余成本法核算，因此，公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等；

(2) 所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段         | 净值收益率①  | 净值收益率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③     | ②-④     |
|------------|---------|-----------|------------|---------------|---------|---------|
| 过去三个月      | 0.2924% | 0.0003%   | 0.0865%    | 0.0000%       | 0.2059% | 0.0003% |
| 过去六个月      | 0.5736% | 0.0003%   | 0.1722%    | 0.0000%       | 0.4014% | 0.0003% |
| 过去一年       | 1.1174% | 0.0004%   | 0.3479%    | 0.0000%       | 0.7695% | 0.0004% |
| 自基金合同生效起至今 | 1.3748% | 0.0005%   | 0.4120%    | 0.0000%       | 0.9628% | 0.0005% |

#### 3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：按集合计划合同和招募说明书的约定，本集合计划建仓期为合同生效后6个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同有关规定。

## §4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名  | 职务         | 任本基金的基金经理期限 |      | 证券从业年限 | 说明  |
|-----|------------|-------------|------|--------|---|
|     |            | 任职日期        | 离任日期 |        |   |
| 陈功谋 | 本集合计划的基金经理 | 2022-04-25  | -    | 12     | 武汉大学会计专业硕士，5年以上投资交易经历。2011年入职招商证券股份有限公司财务部，2016年-2017年历任财务部资金交易员、债券交易员，同时负责公司流动性管理工作，2018年-2020年任资金管理部司库投资经理，2020年9月入职招商证券资产管理有限公司固定收益投资部。担任【招商资管智远天添利货币型集合资产管理计划】基金经理（自2022年4月25日起任职）。 |
| 曾琦  | 本集合计划的基金经理 | 2022-04-25  | -    | 18     | CFA，南开大学金融学硕士，18年证券从业和投资经历，现任固定收益投资部基金经理。曾任招商证券股份有限公司资产管理部产品设计经理、理财投资部投资经理。担任【招商资管智远增利债券型集合资产管理计划】基金经理（自2021年11月18日起任职）、【招商资管智远天添利货币型集合资产管理计划】基金经理（自202                                 |

|  |  |  |  |  |              |
|--|--|--|--|--|--------------|
|  |  |  |  |  | 2年4月25日起任职)。 |
|--|--|--|--|--|--------------|

注：（1）对集合计划的首任基金经理，其“任职日期”为集合计划合同生效日，“离任日期”为根据本管理人决定确定的解聘日期；对此后的非首任基金经理，“任职日期”和“离任日期”分别指根据本管理人决定确定的聘任日期和解聘日期；（2）证券从业的含义遵从《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

## 4.2 报告期内本基金运作合规守信情况说明

本报告期内，本集合计划管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等法律法规及集合计划合同、集合计划招募说明书等有关集合计划法律文件的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用集合计划资产，在规范集合计划运作和严格控制投资风险的前提下，为集合计划持有人谋求最大利益，无损害集合计划份额持有人利益的行为。

## 4.3 公平交易专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本集合计划管理人通过合理设立组织架构，建立科学的投资决策体系，加强交易执行环节的内部控制，对投资交易行为的监控、分析评估，公平对待不同投资组合。

本集合计划管理人不断完善研究方法和投资决策流程，建立投资备选库和投资授权制度，投资组合经理在授权范围内自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序，不同投资组合经理之间的持仓和交易重大非公开投资信息相互隔离，实行集中交易制度，遵循公平交易的原则。

本报告期内，上述公平交易制度总体执行情况良好，在研究分析、投资决策、交易执行等各个环节，公平对待旗下所有投资组合。

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，未发生同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的交易。

本报告期内，未发现有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

#### 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

##### (1) 投资回顾

6月中国制造业PMI环比上升0.2个百分点至49%，连续第三个月落入收缩区间，非制造业PMI环比下降1.3个百分点至53.2%，综合PMI产出指数为52.3%，较上月下降0.6个百分点。制造业与非制造业景气度仍然有所分化，新出口订单指数持续下降。6月财新中国制造业PMI为50.5%，继续保持在荣枯线上方，连续两个月处于改善区间，但低于长期均值。整体来看，PMI预示经济延续恢复态势但下行压力仍存，“生产强、需求弱”的情况仍然明显。

政策面上，4月的政治局会议指出，当前我国经济运行好转主要是恢复性的，内生动力还不强，需求仍然不足，经济转型升级面临新的阻力，推动高质量发展仍需要克服不少困难挑战。央行一季度货币政策执行报告表明，政策基调依旧“精准有力”，央行强调“推动企业综合融资成本和个人消费信贷成本稳中有降”。进入6月份后，暨商业银行的存款利率下调后，央行先后下调了公开市场操作7天逆回购利率、MLF和LPR利率，一系列价格型工具的调整，是央行落实降低实体经济融资成本的重要体现。与此同时，6月发改委新闻发布会上提出了不少举措：抓紧制定出台恢复和扩大消费的政策；推动出台促进新能源汽车产业发展的政策举措；积极推动66个国家骨干冷链物流基地建设；鼓励和吸引更多民营企业参与国家重大项目建设；积极支持新型储能科技创新，加快推动规模化应用；高标准高质量建设雄安新区，抓紧研究制定一揽子特殊支持政策。其后，新能源汽车购置税减免政策延长4年，政治局会议也讨论了雄安新区若干政策的建议。

二季度，债市继续反映“弱预期”，受低于预期的经济数据和通胀数据的影响，叠加货币政策宽松和资金面持续改善，债市收益率大幅下行。在央行6月份一系列降息之后，跨季资金价格高企背景下，市场才重归平静。整体来看，短端受货币政策影响下行幅度更大。一个季度来看，1年期国债收益率下行36bp至1.87%；10年期国债收益率下行22bp至2.64%；1年期国开债收益率下行29bp至2.09%；10年期国开债收益率下行25bp至2.77%。

与利率债走势相似，同业存单市场收益率也是大幅下行，一级存单发行利率相对于上个季度下行明显，产品的再投资收益率有一定的影响，组合的静态收益率先上后下。季末产品规模相对日常水平降幅仍然较大，平均剩余期限处于相对较高的水平。安排好



资金到期，保证流动性的同时，在资金紧张时期对优势品种进行投资有利于产品获取超额收益。

## (2) 投资展望

展望未来，中国经济继续维持低位运行，房地产销售在二、三线城市限购等政策逐步放开的背景下仍面临着多重压力，而五一和端午假期，虽出行人数较2019年同期有所增长，但旅游收入总额和人均消费都略显不足，消费能力的恢复仍任重道远。在经济下行的背景下，央行维护流动性合理充裕的政策确定性仍较强，利率价格工具已开启，宽货币需要宽信用政策和产业政策的配合，后续各项政策组合仍然值得预期。短期来看，资产荒逻辑未破，经济基本面全面转弱和资金价格的持续宽松仍将是债券市场的有力支撑，叠加地缘风险，均对风险偏好形成了较强的压制。如果政策层面上结构性稳增长政策如期推出，经济或将延续弱复苏，若后期叠加部分数据转暖，经济信心有望加快修复，利率市场的波动难免，中长端方面还需关注可能的特别国债政策的额外影响。货币政策层面整体偏松，短端受货币政策的直接影响，中短期内会围绕政策利率波动。近期，人民币汇率重获监管的关注，短期内汇率压力仍存但边际趋缓。

我们的主要工作是提前研判大类资产转换、月末季末、节假日效应和汇率等因素对资金利率以及流动性的冲击，保证产品流动性以满足客户赎回需求，并判断未来债券市场的走势，积极调整产品的平均剩余期限。我们也要及时预判股票市场走势对产品规模的影响，合理预计未来的规模变动趋势，控制好投资品种的到期期限，在满足流动性的前提下，逢资金相对紧张时期进行定期存款、存单和短债投资，以提高产品的收益。

## 4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，基金份额净值收益率为0.2924%，同期业绩比较基准收益率为0.0865%。

## 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内，本集合计划未出现连续二十个工作日集合计划份额持有人数量不满二百人或者集合计划资产净值低于五千万元的情形。

## §5 投资组合报告

### 5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额(元) | 占基金总资产的 |
|----|----|-------|---------|
|----|----|-------|---------|



|   |                   |                   | 比例 (%) |
|---|-------------------|-------------------|--------|
| 1 | 固定收益投资            | 17,977,581,055.66 | 40.04  |
|   | 其中：债券             | 17,977,581,055.66 | 40.04  |
|   | 资产支持证券            | -                 | -      |
| 2 | 买入返售金融资产          | 1,389,325,811.00  | 3.09   |
|   | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | -                 | -      |
| 3 | 银行存款和结算备付金合计      | 25,487,374,105.46 | 56.76  |
| 4 | 其他资产              | 49,942,523.08     | 0.11   |
| 5 | 合计                | 44,904,223,495.20 | 100.00 |

## 5.2 报告期债券回购融资情况

| 序号 | 项目           | 占基金资产净值比例(%)     |               |
|----|--------------|------------------|---------------|
| 1  | 报告期内债券回购融资余额 |                  | 5.82          |
|    | 其中：买断式回购融资   |                  | -             |
| 序号 | 项目           | 金额(元)            | 占基金资产净值比例 (%) |
| 2  | 报告期末债券回购融资余额 | 6,924,289,830.32 | 18.25         |
|    | 其中：买断式回购融资   | -                | -             |

注：报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每日融资余额占基金资产净值比例的简单平均值。

## 债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

本报告期内债券正回购的资金余额未超过本集合计划资产净值的20%。

## 5.3 基金投资组合平均剩余期限

### 5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

| 项目             | 天数  |
|----------------|-----|
| 报告期末投资组合平均剩余期限 | 112 |

|                   |     |
|-------------------|-----|
| 报告期内投资组合平均剩余期限最高值 | 115 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最低值 | 83  |

### 报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

本集合计划本报告期内不存在投资组合平均剩余期限超过120天的情况。

### 5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

| 序号 | 平均剩余期限               | 各期限资产占基金资产净值的比例（%） | 各期限负债占基金资产净值的比例（%） |
|----|----------------------|--------------------|--------------------|
| 1  | 30天以内                | 33.86              | 18.25              |
|    | 其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债 | -                  | -                  |
| 2  | 30天(含)—60天           | 14.51              | -                  |
|    | 其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债 | -                  | -                  |
| 3  | 60天（含）—90天           | 12.16              | -                  |
|    | 其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债 | -                  | -                  |
| 4  | 90天(含)—120天          | 11.04              | -                  |
|    | 其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债 | -                  | -                  |
| 5  | 120天(含)—397天（含）      | 46.31              | -                  |
|    | 其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债 | -                  | -                  |
|    | 合计                   | 117.88             | 18.25              |

### 5.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明

本集合计划本报告期内不存在投资组合平均剩余存续期超过240天的情况。

### 5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种               | 摊余成本(元)           | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|--------------------|-------------------|---------------|
| 1  | 国家债券               | -                 | -             |
| 2  | 央行票据               | -                 | -             |
| 3  | 金融债券               | -                 | -             |
|    | 其中：政策性金融债          | -                 | -             |
| 4  | 企业债券               | -                 | -             |
| 5  | 企业短期融资券            | 1,888,905,323.04  | 4.98          |
| 6  | 中期票据               | -                 | -             |
| 7  | 同业存单               | 16,088,675,732.62 | 42.41         |
| 8  | 其他                 | -                 | -             |
| 9  | 合计                 | 17,977,581,055.66 | 47.39         |
| 10 | 剩余存续期超过397天的浮动利率债券 | -                 | -             |

### 5.6 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

| 序号 | 债券代码      | 债券名称            | 债券数量(张)   | 摊余成本(元)        | 占基金资产净值比例(%) |
|----|-----------|-----------------|-----------|----------------|--------------|
| 1  | 112303131 | 23农业银行C<br>D131 | 6,000,000 | 586,355,382.33 | 1.55         |
| 2  | 112214153 | 22江苏银行C<br>D153 | 5,000,000 | 497,633,250.50 | 1.31         |
| 3  | 112310026 | 23兴业银行C<br>D026 | 5,000,000 | 496,166,051.87 | 1.31         |
| 4  | 112303070 | 23农业银行C<br>D070 | 5,000,000 | 496,027,569.89 | 1.31         |
| 5  | 112310040 | 23兴业银行C<br>D040 | 5,000,000 | 495,610,981.15 | 1.31         |
| 6  | 112310042 | 23兴业银行C         | 5,000,000 | 495,547,434.35 | 1.31         |

|    |           |                 |           |                |      |
|----|-----------|-----------------|-----------|----------------|------|
|    |           | D042            |           |                |      |
| 7  | 112314055 | 23江苏银行C<br>D055 | 5,000,000 | 489,734,038.32 | 1.29 |
| 8  | 112391787 | 23宁波银行C<br>D015 | 4,500,000 | 448,859,056.99 | 1.18 |
| 9  | 112210336 | 22兴业银行C<br>D336 | 4,000,000 | 399,158,871.75 | 1.05 |
| 10 | 112209152 | 22浦发银行C<br>D152 | 4,000,000 | 397,794,274.96 | 1.05 |

### 5.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

| 项目                           | 偏离情况     |
|------------------------------|----------|
| 报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数 | 0        |
| 报告期内偏离度的最高值                  | 0.0525%  |
| 报告期内偏离度的最低值                  | -0.0073% |
| 报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值       | 0.0242%  |

#### 报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

本集合计划本报告期内不存在负偏离度的绝对值达到0.25%的情况。

#### 报告期内正偏离度的绝对值达到0.5%情况说明

本集合计划本报告期内不存在正偏离度的绝对值达到0.5%的情况。

### 5.8 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本集合计划本报告期末未持有资产支持证券。

### 5.9 投资组合报告附注

#### 5.9.1 基金计价方法说明

本集合计划通过每日计算基金收益并分配的方式，使基金份额净值保持在人民币 1.00 元。本集合计划估值采用摊余成本法，即估值对象以买入成本列示，按票面利率或

商定利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余期限内按照实际利率法每日计提收益。

**5.9.2** 本集合计划投资的前十名证券的发行主体中，在报告编制日前一年内，江苏银行股份有限公司曾受到中国人民银行及其派出机构的处罚，中国农业银行股份有限公司、兴业银行股份有限公司、宁波银行股份有限公司曾受到国家金融监督管理总局及其派出机构的处罚，上海浦东发展银行股份有限公司曾受到国家外汇管理局上海市分局、上海市市场监管局的处罚。处罚力度和性质对该公司长期经营业绩未产生重大负面影响，不影响相关证券标的长期投资价值。本集合计划对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规的要求。

除上述主体外，未发现期末投资的其他前十名证券的发行主体出现本期被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

### 5.9.3 其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额(元)         |
|----|---------|---------------|
| 1  | 存出保证金   | -             |
| 2  | 应收证券清算款 | 49,942,523.08 |
| 3  | 应收利息    | -             |
| 4  | 应收申购款   | -             |
| 5  | 其他应收款   | -             |
| 6  | 其他      | -             |
| 7  | 合计      | 49,942,523.08 |

### 5.9.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## §6 开放式基金份额变动

单位：份

|              |                    |
|--------------|--------------------|
| 报告期期初基金份额总额  | 38,780,954,493.36  |
| 报告期期间基金总申购份额 | 245,429,170,901.30 |

|              |                    |
|--------------|--------------------|
| 报告期期间基金总赎回份额 | 246,277,150,189.54 |
| 报告期期末基金份额总额  | 37,932,975,205.12  |

### §7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

| 序号 | 交易方式 | 交易日期       | 交易份额（份）         | 交易金额（元）         | 适用费率 |
|----|------|------------|-----------------|-----------------|------|
| 1  | 申赎   | 2023-04-03 | -776,196,258.00 | -776,196,258.00 | 0    |
| 2  | 买卖   | 2023-04-03 | 536,001,416.00  | 536,001,416.00  | 0    |
| 3  | 申赎   | 2023-04-04 | -536,001,416.00 | -536,001,416.00 | 0    |
| 4  | 买卖   | 2023-04-04 | 732,468,716.00  | 732,468,716.00  | 0    |
| 5  | 申赎   | 2023-04-06 | -732,468,716.00 | -732,468,716.00 | 0    |
| 6  | 买卖   | 2023-04-06 | 725,481,427.00  | 725,481,427.00  | 0    |
| 7  | 申赎   | 2023-04-07 | -725,481,427.00 | -725,481,427.00 | 0    |
| 8  | 买卖   | 2023-04-07 | 876,119,916.00  | 876,119,916.00  | 0    |
| 9  | 申赎   | 2023-04-10 | -876,119,916.00 | -876,119,916.00 | 0    |
| 10 | 买卖   | 2023-04-10 | 701,316,232.00  | 701,316,232.00  | 0    |
| 11 | 申赎   | 2023-04-11 | -701,316,232.00 | -701,316,232.00 | 0    |
| 12 | 买卖   | 2023-04-11 | 745,303,210.00  | 745,303,210.00  | 0    |
| 13 | 申赎   | 2023-04-12 | -745,303,210.00 | -745,303,210.00 | 0    |
| 14 | 买卖   | 2023-04-12 | 540,798,625.00  | 540,798,625.00  | 0    |
| 15 | 申赎   | 2023-04-13 | -540,798,625.00 | -540,798,625.00 | 0    |
| 16 | 买卖   | 2023-04-13 | 553,289,631.00  | 553,289,631.00  | 0    |
| 17 | 申赎   | 2023-04-14 | -553,289,631.00 | -553,289,631.00 | 0    |
| 18 | 买卖   | 2023-04-14 | 576,852,349.00  | 576,852,349.00  | 0    |
| 19 | 申赎   | 2023-04-17 | -576,852,349.00 | -576,852,349.00 | 0    |
| 20 | 买卖   | 2023-04-17 | 550,565,964.00  | 550,565,964.00  | 0    |
| 21 | 申赎   | 2023-04-18 | -550,565,964.00 | -550,565,964.00 | 0    |
| 22 | 买卖   | 2023-04-18 | 595,792,097.00  | 595,792,097.00  | 0    |

|    |    |            |                 |                 |   |
|----|----|------------|-----------------|-----------------|---|
| 23 | 申赎 | 2023-04-19 | -595,792,097.00 | -595,792,097.00 | 0 |
| 24 | 买卖 | 2023-04-19 | 517,470,721.00  | 517,470,721.00  | 0 |
| 25 | 申赎 | 2023-04-20 | -517,470,721.00 | -517,470,721.00 | 0 |
| 26 | 买卖 | 2023-04-20 | 509,522,074.00  | 509,522,074.00  | 0 |
| 27 | 申赎 | 2023-04-21 | -509,522,074.00 | -509,522,074.00 | 0 |
| 28 | 买卖 | 2023-04-21 | 527,556,020.00  | 527,556,020.00  | 0 |
| 29 | 申赎 | 2023-04-24 | -527,556,020.00 | -527,556,020.00 | 0 |
| 30 | 买卖 | 2023-04-24 | 579,004,346.00  | 579,004,346.00  | 0 |
| 31 | 申赎 | 2023-04-25 | -579,004,346.00 | -579,004,346.00 | 0 |
| 32 | 买卖 | 2023-04-25 | 602,855,280.00  | 602,855,280.00  | 0 |
| 33 | 申赎 | 2023-04-26 | -602,855,280.00 | -602,855,280.00 | 0 |
| 34 | 买卖 | 2023-04-26 | 486,508,596.00  | 486,508,596.00  | 0 |
| 35 | 申赎 | 2023-04-27 | -486,508,596.00 | -486,508,596.00 | 0 |
| 36 | 买卖 | 2023-04-27 | 549,758,356.00  | 549,758,356.00  | 0 |
| 37 | 申赎 | 2023-04-28 | -549,758,356.00 | -549,758,356.00 | 0 |
| 38 | 买卖 | 2023-04-28 | 766,078,221.00  | 766,078,221.00  | 0 |
| 39 | 申赎 | 2023-05-04 | -766,078,221.00 | -766,078,221.00 | 0 |
| 40 | 买卖 | 2023-05-04 | 578,559,638.00  | 578,559,638.00  | 0 |
| 41 | 申赎 | 2023-05-05 | -578,559,638.00 | -578,559,638.00 | 0 |
| 42 | 买卖 | 2023-05-05 | 738,914,722.00  | 738,914,722.00  | 0 |
| 43 | 申赎 | 2023-05-08 | -738,914,722.00 | -738,914,722.00 | 0 |
| 44 | 买卖 | 2023-05-08 | 663,940,138.00  | 663,940,138.00  | 0 |
| 45 | 申赎 | 2023-05-09 | -663,940,138.00 | -663,940,138.00 | 0 |
| 46 | 买卖 | 2023-05-09 | 749,802,603.00  | 749,802,603.00  | 0 |
| 47 | 申赎 | 2023-05-10 | -749,802,603.00 | -749,802,603.00 | 0 |
| 48 | 买卖 | 2023-05-10 | 508,547,524.00  | 508,547,524.00  | 0 |
| 49 | 申赎 | 2023-05-11 | -508,547,524.00 | -508,547,524.00 | 0 |



|    |    |            |                 |                 |   |
|----|----|------------|-----------------|-----------------|---|
| 50 | 买卖 | 2023-05-11 | 499,218,250.00  | 499,218,250.00  | 0 |
| 51 | 申赎 | 2023-05-12 | -499,218,250.00 | -499,218,250.00 | 0 |
| 52 | 买卖 | 2023-05-12 | 568,933,428.00  | 568,933,428.00  | 0 |
| 53 | 申赎 | 2023-05-15 | -568,933,428.00 | -568,933,428.00 | 0 |
| 54 | 买卖 | 2023-05-15 | 511,288,252.00  | 511,288,252.00  | 0 |
| 55 | 申赎 | 2023-05-16 | -511,288,252.00 | -511,288,252.00 | 0 |
| 56 | 买卖 | 2023-05-16 | 554,588,266.00  | 554,588,266.00  | 0 |
| 57 | 申赎 | 2023-05-17 | -554,588,266.00 | -554,588,266.00 | 0 |
| 58 | 买卖 | 2023-05-17 | 390,498,282.00  | 390,498,282.00  | 0 |
| 59 | 申赎 | 2023-05-18 | -390,498,282.00 | -390,498,282.00 | 0 |
| 60 | 买卖 | 2023-05-18 | 463,669,535.00  | 463,669,535.00  | 0 |
| 61 | 申赎 | 2023-05-19 | -463,669,535.00 | -463,669,535.00 | 0 |
| 62 | 买卖 | 2023-05-19 | 463,730,032.00  | 463,730,032.00  | 0 |
| 63 | 申赎 | 2023-05-22 | -463,730,032.00 | -463,730,032.00 | 0 |
| 64 | 买卖 | 2023-05-22 | 420,183,127.00  | 420,183,127.00  | 0 |
| 65 | 申赎 | 2023-05-23 | -420,183,127.00 | -420,183,127.00 | 0 |
| 66 | 买卖 | 2023-05-23 | 592,702,019.00  | 592,702,019.00  | 0 |
| 67 | 申赎 | 2023-05-24 | -592,702,019.00 | -592,702,019.00 | 0 |
| 68 | 买卖 | 2023-05-24 | 393,727,692.00  | 393,727,692.00  | 0 |
| 69 | 申赎 | 2023-05-25 | -393,727,692.00 | -393,727,692.00 | 0 |
| 70 | 买卖 | 2023-05-25 | 405,449,018.00  | 405,449,018.00  | 0 |
| 71 | 申赎 | 2023-05-26 | -405,449,018.00 | -405,449,018.00 | 0 |
| 72 | 买卖 | 2023-05-26 | 470,134,609.00  | 470,134,609.00  | 0 |
| 73 | 申赎 | 2023-05-29 | -470,134,609.00 | -470,134,609.00 | 0 |
| 74 | 买卖 | 2023-05-29 | 483,476,145.00  | 483,476,145.00  | 0 |
| 75 | 申赎 | 2023-05-30 | -483,476,145.00 | -483,476,145.00 | 0 |
| 76 | 买卖 | 2023-05-30 | 545,709,865.00  | 545,709,865.00  | 0 |

|     |    |            |                 |                 |   |
|-----|----|------------|-----------------|-----------------|---|
| 77  | 申赎 | 2023-05-31 | -545,709,865.00 | -545,709,865.00 | 0 |
| 78  | 买卖 | 2023-05-31 | 483,562,187.00  | 483,562,187.00  | 0 |
| 79  | 申赎 | 2023-06-01 | -483,562,187.00 | -483,562,187.00 | 0 |
| 80  | 买卖 | 2023-06-01 | 420,053,986.00  | 420,053,986.00  | 0 |
| 81  | 申赎 | 2023-06-02 | -420,053,986.00 | -420,053,986.00 | 0 |
| 82  | 买卖 | 2023-06-02 | 456,240,544.00  | 456,240,544.00  | 0 |
| 83  | 申赎 | 2023-06-05 | -456,240,544.00 | -456,240,544.00 | 0 |
| 84  | 买卖 | 2023-06-05 | 544,783,541.00  | 544,783,541.00  | 0 |
| 85  | 申赎 | 2023-06-06 | -544,783,541.00 | -544,783,541.00 | 0 |
| 86  | 买卖 | 2023-06-06 | 483,212,828.00  | 483,212,828.00  | 0 |
| 87  | 申赎 | 2023-06-07 | -483,212,828.00 | -483,212,828.00 | 0 |
| 88  | 买卖 | 2023-06-07 | 482,647,309.00  | 482,647,309.00  | 0 |
| 89  | 申赎 | 2023-06-08 | -482,647,309.00 | -482,647,309.00 | 0 |
| 90  | 买卖 | 2023-06-08 | 428,906,333.00  | 428,906,333.00  | 0 |
| 91  | 申赎 | 2023-06-09 | -428,906,333.00 | -428,906,333.00 | 0 |
| 92  | 买卖 | 2023-06-09 | 494,610,653.00  | 494,610,653.00  | 0 |
| 93  | 申赎 | 2023-06-12 | -494,610,653.00 | -494,610,653.00 | 0 |
| 94  | 买卖 | 2023-06-12 | 548,828,728.00  | 548,828,728.00  | 0 |
| 95  | 申赎 | 2023-06-13 | -548,828,728.00 | -548,828,728.00 | 0 |
| 96  | 买卖 | 2023-06-13 | 448,013,536.00  | 448,013,536.00  | 0 |
| 97  | 申赎 | 2023-06-14 | -448,013,536.00 | -448,013,536.00 | 0 |
| 98  | 买卖 | 2023-06-14 | 490,005,417.00  | 490,005,417.00  | 0 |
| 99  | 申赎 | 2023-06-15 | -490,005,417.00 | -490,005,417.00 | 0 |
| 100 | 买卖 | 2023-06-15 | 496,642,892.00  | 496,642,892.00  | 0 |
| 101 | 申赎 | 2023-06-16 | -496,642,892.00 | -496,642,892.00 | 0 |
| 102 | 买卖 | 2023-06-16 | 590,285,399.00  | 590,285,399.00  | 0 |
| 103 | 申赎 | 2023-06-19 | -590,285,399.00 | -590,285,399.00 | 0 |

|     |    |            |                 |                 |   |
|-----|----|------------|-----------------|-----------------|---|
| 104 | 买卖 | 2023-06-19 | 718,488,911.00  | 718,488,911.00  | 0 |
| 105 | 申赎 | 2023-06-20 | -718,488,911.00 | -718,488,911.00 | 0 |
| 106 | 买卖 | 2023-06-20 | 692,026,855.00  | 692,026,855.00  | 0 |
| 107 | 申赎 | 2023-06-21 | -692,026,855.00 | -692,026,855.00 | 0 |
| 108 | 买卖 | 2023-06-21 | 638,178,578.00  | 638,178,578.00  | 0 |
| 109 | 申赎 | 2023-06-26 | -638,178,578.00 | -638,178,578.00 | 0 |
| 110 | 买卖 | 2023-06-26 | 677,085,427.00  | 677,085,427.00  | 0 |
| 111 | 申赎 | 2023-06-27 | -677,085,427.00 | -677,085,427.00 | 0 |
| 112 | 买卖 | 2023-06-27 | 618,641,013.00  | 618,641,013.00  | 0 |
| 113 | 申赎 | 2023-06-28 | -618,641,013.00 | -618,641,013.00 | 0 |
| 114 | 买卖 | 2023-06-28 | 541,648,287.00  | 541,648,287.00  | 0 |
| 115 | 申赎 | 2023-06-29 | -541,648,287.00 | -541,648,287.00 | 0 |
| 116 | 买卖 | 2023-06-29 | 557,903,592.00  | 557,903,592.00  | 0 |
| 117 | 申赎 | 2023-06-30 | -557,903,592.00 | -557,903,592.00 | 0 |
| 118 | 买卖 | 2023-06-30 | 708,974,173.00  | 708,974,173.00  | 0 |
| 合计  |    |            | -67,222,085.00  | -67,222,085.00  |   |

注：期间买入份额交易方式为非交易过户，为管理人提供快取功能产生的份额。

## §8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

本集合计划本报告期未出现单一投资者持有集合计划份额比例达到或超过20%的情况。

### 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## §9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

1. 中国证券监督管理委员会关于准予招商证券智远天添利集合资产管理计划合同变更的回函；
2. 《招商资管智远天添利货币型集合资产管理计划集合资产管理合同》；
3. 《招商资管智远天添利货币型集合资产管理计划托管协议》；
4. 《招商资管智远天添利货币型集合资产管理计划招募说明书》；
5. 《招商资管智远天添利货币型集合资产管理计划产品资料概要》；
6. 集合计划管理人业务资格批件、营业执照；
7. 中国证券监督管理委员会要求的其他文件。

## 9.2 存放地点

备查文件存放于集合计划管理人和集合计划托管人的办公场所，并登载于集合计划管理人互联网站<https://amc.cmschina.com/>。

## 9.3 查阅方式

投资者可登录集合计划管理人互联网站查阅，或在营业时间内至集合计划管理人或集合计划托管人的办公场所免费查阅。

投资者对本报告如有疑问，敬请致电或登录管理人网站了解相关情况，咨询电话：95565，公司网站：<https://amc.cmschina.com/>。

招商证券资产管理有限公司

2023年07月20日